



Gesamtbanksteuerung und Risikocontrolling, Revision und Compliance

Erfahrungsaustauschgruppe für mittelständische Banken
von Prof. Dr. Stefan Zeranski & KollegInnen

Nächstes Treffen: 09./10.05.2016 in Freising

Geschäfts- und Risikoprofil der Banken im Fokus der Aufsicht

Mit der Erfahrungsaustauschgruppe »Gesamtbanksteuerung und Risikocontrolling, Revision und Compliance« ist es unser Anliegen, ein dauerhaftes, übergreifendes und praxisbezogenes Netzwerk zu schaffen, indem ein fortlaufender Gedanken- und Erfahrungsaustausch innerhalb des jeweiligen Themenbereichs stattfindet. Ziel ist es auch, gemeinsame Arbeitspapiere als sogenannte Masterdokumente zu erstellen, um Synergien auf der Arbeitsebene für das Tagesgeschäft zu schaffen und für die Umsetzung Anregungen aus der Gruppe zu erhalten.

Ziel dabei ist es, die Kommunikation zwischen den Praktikern untereinander zu fördern und gegenseitig neue fachliche Anregungen mit wissenschaftlicher Unterstützung zu erhalten. In der Gruppe werden u. a. Aspekte der Gesamtbanksteuerung mit Blick auf die neuen

regulatorischen Anforderungen der MaRisk, CRR, CRD IV, FinaRisikoV sowie die Auswirkungen der Basel III-Ratios, des CRD IV-Umsetzungsgesetzes und der neuen MaSan im Licht der aktuellen Finanzkrise, der künftigen bankaufsichtlichen Prüfungen mit dem neuen SREP in der EU Bankenunion, des Niedrigzinsumfelds und der Staatsanleihenkäufe der EZB diskutiert.

Uns ist es wichtig, dass die Teilnehmer die für sie interessanten Themen zum Großteil selbst bestimmen können und mit wissenschaftlicher Unterstützung praxisbezogen ausarbeiten aber auch ihre Lösungsansätze in der Gruppe präsentieren und Feedback aus der Gruppe erhalten sowie Probleme aus dem Tagesgeschäft ausführlich diskutieren können.

Die Zielgruppe	Die Erfahrungsaustauschgruppe richtet sich vor allem an Fach- und Führungskräfte in den Funktionen Controlling, Risikocontrolling, Depot A, Treasury, Revision, Compliance.
Ihr Nutzen	Die Erfahrungsaustauschgruppe schafft einen nachhaltigen Mehrwert: <ul style="list-style-type: none">✓ Teilnehmer definieren die Themen und stellen ihre Lösungsansätze vor✓ Erarbeitung gemeinsamer Arbeitspapiere als »Masterdokumente«✓ Erfahrungsaustausch schafft Synergien für die eigene Projektarbeit✓ Benchmarking der eigenen Vorgehensweise mit dem Vorgehen in der Gruppe✓ »Blick über den Tellerrand« mit regelmäßigem Austausch auf gleicher Ebene✓ Protokollierung der Arbeitsergebnisse, Verteilung wichtiger Dokumente/Checklisten
Inhalt der Erfahrungsaustauschgruppe	<ul style="list-style-type: none">✓ Diskussionen und Erfahrungsaustausch✓ Themenfestlegung gemeinsam mit den Teilnehmern✓ Vorstellung eigener Lösungsansätze und Diskussion mit den Teilnehmern✓ Wahrung der wettbewerbsrechtlichen Neutralität✓ 1,5 tägige Arbeitstreffen pro Halbjahr✓ maximal 30 teilnehmende Unternehmen pro Gruppe✓ Nicht-Branchenunternehmen max. 25 %✓ Ehrenkodex der Vertraulichkeit in der Gruppe✓ Dokumente der Arbeitstreffen mit themenspezifischen Publikationen, Internetlinks✓ Fester Ansprechpartner für fachliche und organisatorische Fragen
Beitrag pro Halbjahr	für den 1. Teilnehmer: 750 EUR für den 2. Teilnehmer: 450 EUR (Mindestzugehörigkeit 1 Jahr) Alle Preise verstehen sich zzgl. MwSt und sind im Voraus zu zahlen.
Fachliche Leitung	Prof. Dr. Stefan Zeranski +49 152 / 218 870 85
Kontakt und Anmeldung	info@profzeranski.de

Agenda



Prof. Dr. Stefan Zeranski

Stefan Zeranski ist seit 2009 Professor für Finanzdienstleistungen und Finanzmanagement an der Fakultät Recht bzw. Brunswick European Law School (BELS), Ostfalia Hochschule für angewandte Wissenschaften. An der BELS ist er Mitglied des Direktoriums für Recht, Finanzen und Steuern und seit März 2014 Dekan der Fakultät Recht. Vor seinem Wechsel an die Hochschule war er insgesamt 15 Jahre in Banken tätig, von 2004 bis 2009 Leiter Treasury der Kölner Bank eG, Prokurist, Direktor, Bereichsleiter, Vertreter des Handelsvorstandes. Weiterhin unterstützt er die Kölner Bank als Berater im Treasury sowie andere Banken und Unternehmen.

Fachliche und organisatorische Ansprechpartner

Herr Axel Szybay
+49 175 / 299 20 14

Herr Arnt Striese
+49 176 / 234 22 68 0

1. Tag	
Eintreffen der TeilnehmerInnen, Begrüßungskaffee	ab 9.00 Uhr
Begrüßung, Überblick über den Tagesverlauf, Nachschau Regulierungsmonitor <i>Prof. Dr. Stefan Zeranski</i>	9.30 Uhr
Aufsichts-Kennzahlen-Dashboard: Kennzahlen der Aufsicht zu Banken, Sanierungs- und Abwicklungsindikatoren, FinaRisikoV-Kennzahlen, Controlling-Würfel <i>Prof. Dr. Stefan Zeranski / Pascal Di Prima-LL.M. Simmons & Simmons LLP</i>	
Kaffeepause	11.00 Uhr
SREP – Teil I: BMA-Geschäftsmodellanalyse, Nachhaltigkeitsbericht, „no overly optimistic assumptions“ <i>Frank Wunderlich – Südwestbank AG</i>	11.30 Uhr
Mittagspause	13.00 Uhr
SREP – Teil II: Fit & Proper-Anforderungen – Leitungs- und Schlüsselfunktionen auf dem Prüfstand (inkl. Aufsichtsrat) <i>Jörg Wrede-Bankhaus Rautenschlein / Pascal Di Prima-LL.M. Simmons & Simmons LLP</i>	14.00 Uhr
Kaffeepause	15.15 Uhr
Impulsvortrag und Diskussion bzw. Gruppenarbeit: Risikoübergreifende Stresstests in Verbindung mit Methoden, Aufsichtsquellen, Beispiele aus 108 Stresstests vom Universal Investment-Spezialfondsreporting <i>Prof. Dr. Stefan Zeranski / Matthias Eizenhoefer-Universal Investment / Gruppe</i>	15.45 Uhr
Ende des ersten Tages	18.00 Uhr
Einladung zum Abendessen in das Restaurant „Bräustüberl Weihenstephan“	ab 19.00 Uhr
2. Tag	
Eintreffen der TeilnehmerInnen, Begrüßungskaffee	Ab 8.30 Uhr
Impulsvortrag, Praxisbericht, Gruppenarbeit: LCR-Risikoanalyse und -Steuerung, Meldewesendatenbasis, Pflichtenheft, Software <i>Prof. Dr. Stefan Zeranski / Stefan Koch-Bank11 / Rolf Scheuber-AXA Bank AG / Gruppe</i>	9.00 Uhr
Kaffeepause	11.30 Uhr
Reputationsrisiko / Conduct Risiko in Banken: Aufsichtsquellen und Beispiele <i>Dr. Martin Wolf-AXA Bank AG</i>	12.00 Uhr
Mittagspause	13.00 Uhr
IT-SiG / MaSI / IT-Risikomanagement / § 13 PrüfbV, BCBS 239 <i>Arnt Striese-Bankhaus C. L. Seeliger</i>	14.00 Uhr
Feedback – Themen- und Terminfindung für das nächste Arbeitstreffen <i>Prof. Dr. Stefan Zeranski, Arnt Striese, Axel Szybay</i>	
Ende des Arbeitstreffens	15.30 Uhr

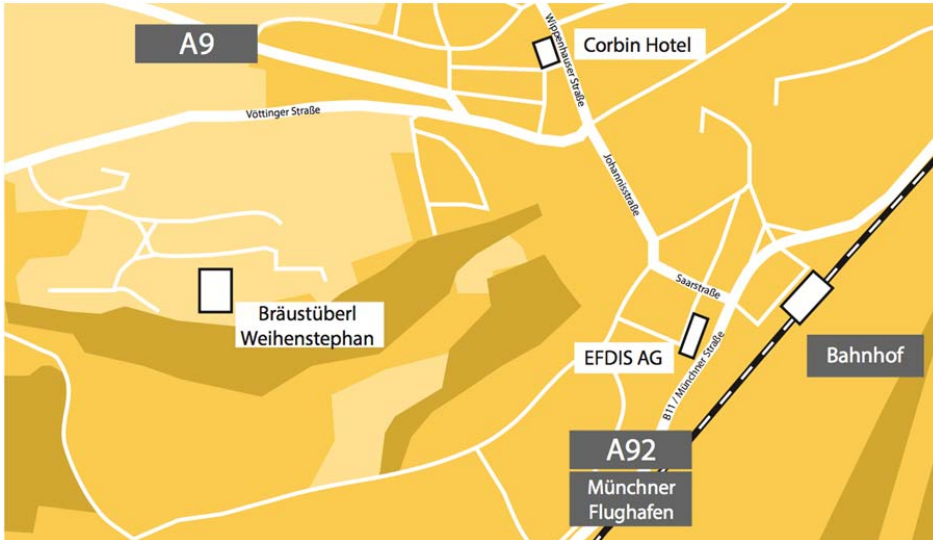
Veranstaltung

Termin des nächsten Arbeitstreffens

07./08. November 2016
Beginn: Montag um 9.30 Uhr,
abends Einladung zum Essen.

Veranstalter

Prof. Zeranski & KollegInnen
info@profzeranski.de
Prof. Dr. Stefan Zeranski
Mutzer Str. 123
51467 Bergisch Gladbach

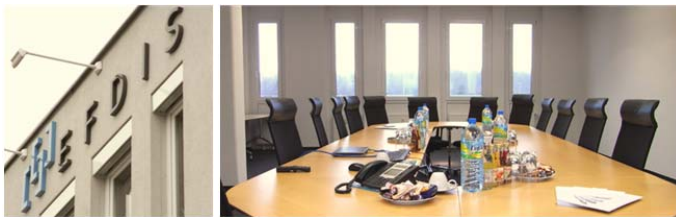


Anreise

mit dem Flugzeug
Flughafen München, MUC, in unmittelbarer Nähe (Taxifahrt: 15 Minuten)

mit der Bahn
Bahnhof fußläufig 2 Minuten vom Veranstaltungsort entfernt Anbindung MVV (S-Bahn-Linie 1)

mit dem Auto
Autobahn A9 (Ausfahrt Al-lershausen) oder A92 (Ausfahrt Freising-Mitte) Veranstaltungsort an der B11



Veranstaltungsort des nächsten Treffens

EFDIS AG
Münchner Straße 8
85354 Freising

www.efdis.de

Hotel in der Nähe des Veranstaltungsortes

Corbin Feng Shui Business Hotel
Wippenhauser Straße 7
85354 Freising
Tel.: +49 81 61 / 24 89-990
Fax: +49 81 61 / 88 69-588

Email: info@corbin-hotel.de



Gemeinsames Abendessen

Bräustüberl Weihenstephan
Weihenstephaner Berg 10
85354 Freising

www.braeustueberl-weihenstephan.de



Mögliche Themen- und Arbeitsschwerpunkte für zukünftige Treffen:

- ✓ Geschäfts- und Risikostrategien im Licht des neuen SREP
- ✓ Kreditrisiko, Rating und Ausfallwahrscheinlichkeiten, Kreditrisikostrategie
- ✓ Zinsrisiko, Marktpreisrisiko- und Depot A-Strategie im Niedrigzinsumfeld
- ✓ Liquiditätsrisiko, -verrechnung, Liquiditätssteuerung, Liquiditätsrisikostrategie, ILAAP
- ✓ Checklisten für die Banksteuerung zur Vermeidung von Organisationsverschulden
- ✓ Sanierungshandbuch, MaSan (light), SAG
- ✓ Qualifizierung, Zertifizierung von Leitungs-/Schlüsselfunktionen (EBA GL 22.11.2012)
- ✓ Datenqualität im Controlling, Meldewesen et al., BCBS 239
- ✓ Weitere Themen aus dem Teilnehmerkreis